

Случайные процессы ПМИ

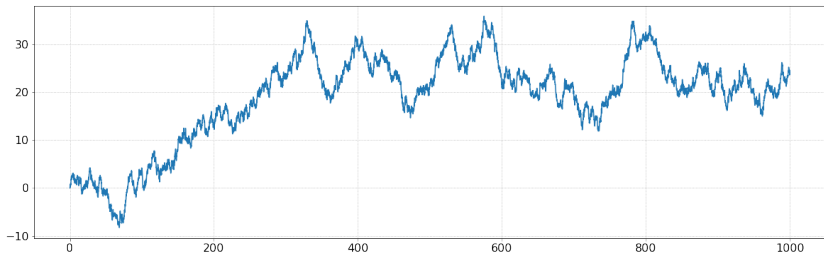
Прикладной поток

Семинар 7

ФИБТ МФТИ

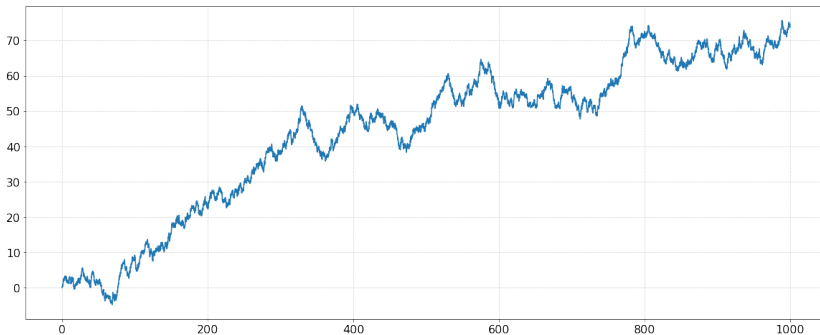
# Траектории винеровского процесса

# Винеровский процесс



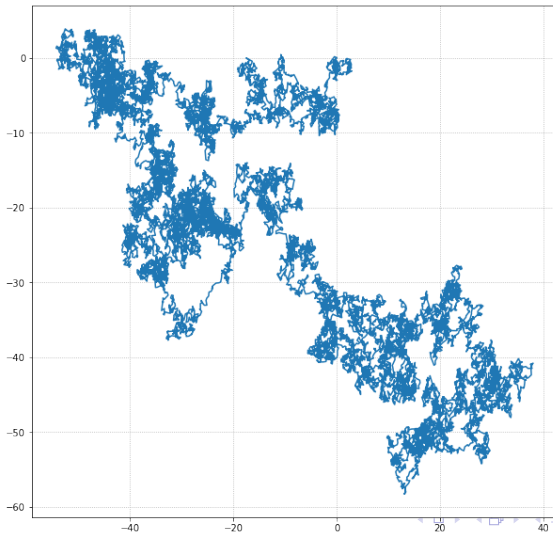
# Винеровский процесс со сносом

$$W_t^\mu = \mu t + W_t$$



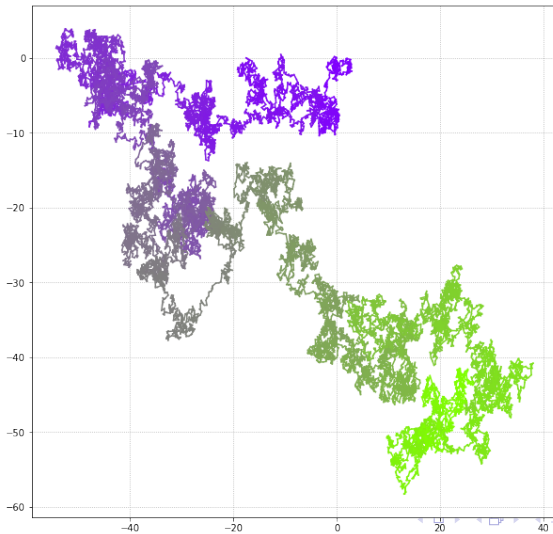
## Двумерный винеровский процесс

$W_t = (W_t^1, W_t^2)$ , где  $W_t^1, W_t^2$  — независимые винеровские процессы



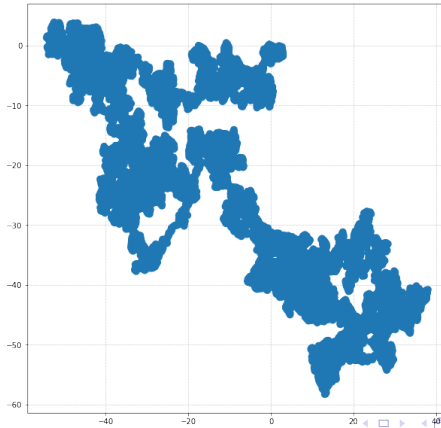
## Двумерный винеровский процесс

$W_t = (W_t^1, W_t^2)$ , где  $W_t^1, W_t^2$  — независимые винеровские процессы



## Сосиска Винера

Сосиска Винера  $W_\delta(t)$  радиуса  $\delta$  и длины  $t$  — множество всех точек, которые находятся на расстоянии не более  $\delta$  от некоторой точки траектории винеровского процесса на отрезке  $[0, t]$ .



## Двумерный винеровский процесс со сносом

$W_t^\mu = (\mu_1 t + W_t^1, \mu_2 t + W_t^2)$ , где  $W_t^1, W_t^2$  — независимые

винеровские процессы

